

# 汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数 证券投资基金（QDII）2023 年中期报告

2023 年 06 月 30 日

基金管理人：汇添富基金管理股份有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2023 年 08 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 8 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

§ 1 重要提示及目录 .....	2
1.1 重要提示 .....	2
1.2 目录 .....	3
§ 2 基金简介 .....	5
2.1 基金基本情况 .....	5
2.2 基金产品说明 .....	5
2.3 基金管理人和基金托管人 .....	5
2.4 境外投资顾问和境外资产托管人 .....	6
2.5 信息披露方式 .....	6
2.6 其他相关资料 .....	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现 .....	6
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	6
3.2 基金净值表现 .....	7
§ 4 管理人报告 .....	8
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	8
4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的成员简介 .....	13
4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....	13
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	13
4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 .....	14
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	16
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 .....	16
§ 5 托管人报告 .....	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 .....	16
5.3 托管人对中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 .....	16
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计） .....	16
6.1 资产负债表 .....	17
6.2 利润表 .....	18
6.3 净资产（基金净值）变动表 .....	19
6.4 报表附注 .....	20
§ 7 投资组合报告 .....	44
7.1 期末基金资产组合情况 .....	44
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布 .....	45
7.3 期末按行业分类的权益投资组合 .....	45
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的权益投资明细 .....	46
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动 .....	102
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合 .....	104
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....	104

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	104
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细	104
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细	104
7.11 投资组合报告附注	104
§ 8 基金份额持有人信息	105
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	105
8.2 期末上市基金前十名持有人	105
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	106
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	106
§ 9 开放式基金份额变动	106
§ 10 重大事件揭示	106
10.1 基金份额持有人大会决议	106
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	106
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	107
10.4 基金投资策略的改变	107
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	107
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	107
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	107
10.8 其他重大事件	109
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	110
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情况	110
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	111
§ 12 备查文件目录	111
12.1 备查文件目录	111
12.2 存放地点	112
12.3 查阅方式	112

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金 (QDII)
基金简称	汇添富纳斯达克生物科技 ETF
场内简称	纳指生物
基金主代码	513290
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2022 年 08 月 15 日
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额 (份)	93,072,120.00
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2022 年 08 月 29 日

注：扩位证券简称：纳指生物科技 ETF。

### 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要采用完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足等）导致本基金无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合，追求尽可能贴近目标指数的表现。本基金的投资策略主要包括：资产配置策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、金融衍生工具投资策略、参与境内融资投资策略、参与境内转融通证券出借业务策略、境内外存托凭证的投资策略。
业绩比较基准	经人民币汇率调整的纳斯达克生物科技指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时本基金为指数基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。本基金主要投资于境外证券市场，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还将面临汇率风险、境外证券市场风险等特殊投资风险。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	汇添富基金管理股份有限公司	中国银行股份有限公司

信息披露 负责人	姓名	李鹏	许俊
	联系电话	021-28932888	010-66596688
	电子邮箱	service@99fund.com	fxjd_hq@bank-of-china.com
客户服务电话		400-888-9918	95566
传真		021-28932998	010-66594942
注册地址		上海市黄浦区北京东路666号H区(东座)6楼H686室	北京市西城区复兴门内大街1号
办公地址		上海市黄浦区外马路728号	北京市西城区复兴门内大街1号
邮政编码		200010	100818
法定代表人		李文	葛海蛟

## 2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外资产托管人
名称	中文	布朗兄弟哈里曼银行
	英文	Brown Brothers Harriman & Co.
注册地址		140 Broadway New York
办公地址		140 Broadway New York
邮政编码		NY 10005

注：本基金无境外投资顾问。

## 2.5 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.99fund.com
基金中期报告备置地点	上海市黄浦区外马路728号 汇添富基金管理股份有限公司

## 2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2023年01月01日 - 2023年06月30日)
---------------	--------------------------------

本期已实现收益	1,417,226.62
本期利润	1,273,716.51
加权平均基金份额本期利润	0.0159
本期加权平均净值利润率	1.50%
本期基金份额净值增长率	0.45%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	<b>报告期末(2023年06月30日)</b>
期末可供分配利润	2,343,158.96
期末可供分配基金份额利润	0.0252
期末基金资产净值	100,514,641.30
期末基金份额净值	1.0800
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>报告期末(2023年06月30日)</b>
基金份额累计净值增长率	8.00%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如：基金的申购赎回费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

### 3.2 基金净值表现

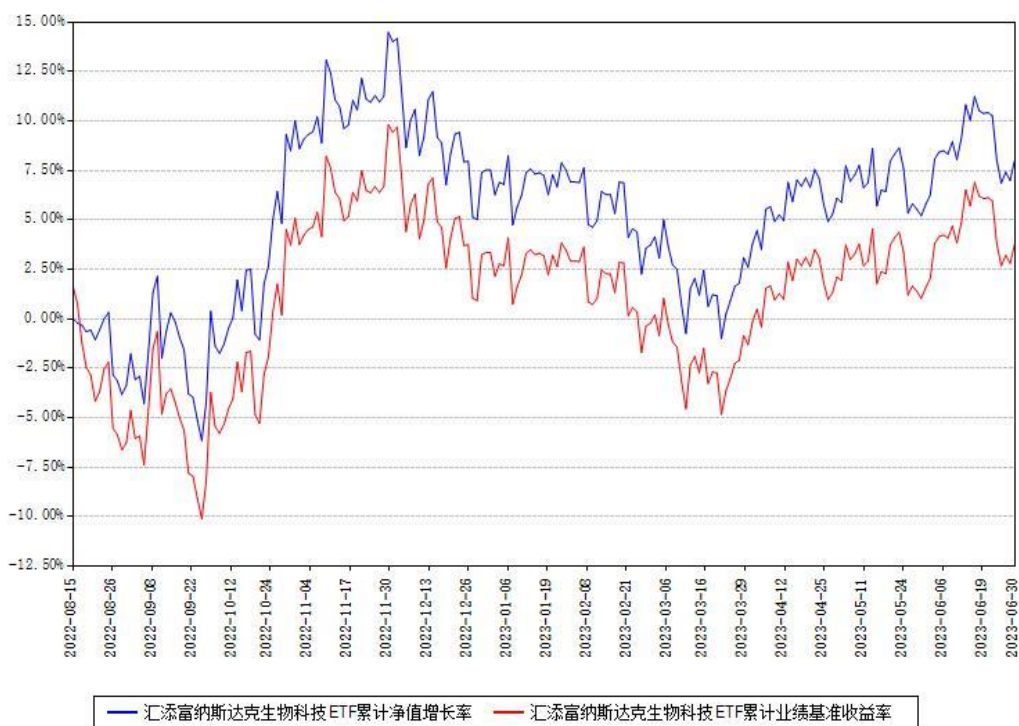
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	2.09%	0.92%	2.13%	0.93%	-0.04%	-0.01%
过去三个月	4.05%	0.97%	3.92%	0.98%	0.13%	-0.01%
过去六个月	0.45%	1.07%	0.40%	1.08%	0.05%	-0.01%
自基金合同生效日起至今	8.00%	1.32%	3.76%	1.36%	4.24%	-0.04%

#### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较

## 基准收益率变动的比较

汇添富纳斯达克生物科技ETF累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



注：本《基金合同》生效之日为2022年08月15日，截至本报告期末，基金成立未满一年。本基金建仓期为本《基金合同》生效之日起6个月，截至本报告期末，本基金已完成建仓，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

汇添富基金成立于2005年2月，是中国一流的综合性资产管理公司之一。公司总部设立于上海，在北京、上海、广州、成都、南京、深圳等地设有分公司，在香港、上海、美国设有子公司——汇添富资产管理（香港）有限公司、汇添富资本管理有限公司、汇添富资产管理（美国）控股有限公司。公司及旗下子公司业务牌照齐全，拥有全国社保基金境内委托投资管理人、全国社保基金境外配售策略方案投资管理人、基本养老保险基金投资管理人、保险资金投资管理人、专户资产管理人、特定客户资产管理子公司、QDII 基金管理人、RQFII 基金管理人、QFII 基金管理人、基金投资顾问等业务资格。

汇添富基金现已形成公募业务、私募资管业务、私募股权业务、养老金业务、电商业务、



国际业务、基金投顾业务等七大业务板块，被誉为“选股专家”，赢得广大基金持有人和海内外机构的认可和信赖。

成立以来，公司屡获殊荣，包括“金牛奖”“金基金奖”“明星基金奖”等多项权威荣誉奖项。汇添富始终坚持“客户第一”的价值观和“一切从长期出发”的经营理念，致力于打造中国最受认可的资产管理品牌。

2023 上半年，汇添富基金新成立 27 只公开募集证券投资基金，包括 10 只股票型基金、9 只混合型基金、8 只债券型基金。截至 2023 年 6 月 30 日，公司共管理 297 只公开募集证券投资基金，形成了覆盖高、中、低各类风险收益特征，较为完善、有效的产品线。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限（年）	说明
		任职日期	离任日期		
过蓓蓓	本基金的基金经理，指数与量化投资部副总监	2022 年 08 月 15 日		12	国籍：中国。学历：中国科学技术大学金融工程博士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：曾任国泰基金管理有限公司金融工程部助理分析师、量化投资部基金经理助理。2015 年 6 月加入汇添富基金管理股份有限公司，现任指数与量化投资部副总监。2015 年 8 月 3 日至今任汇添富中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2015 年 8 月 3 日至 2023 年 4 月 13 日任中证金融地产交易型开放式

				<p>指数证券投资基金的基金经理。</p> <p>2015年8月3日至2023年4月6日任中证能源交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2015年8月3日至今任中证医药卫生交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。</p> <p>2015年8月3日至今任中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2015年8月18日至今任汇添富深证300交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2015年8月18日至2023年5月22日任深证300交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2016年12月22日至今任汇添富中证生物科技主题指数型发起式证券投资基金（LOF）的基金经理。2016年12月29日至2022年12月1日任汇添富中证中药指数型发起式证券投资基金（LOF）的基金经理。2018年5月</p>
--	--	--	--	---

				<p>23 日至今任汇添富中证新能源汽车产业指数型发起式证券投资基金（LOF）的基金经理。2018 年 10 月 23 日至 2023 年 5 月 22 日任中证银行交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2019 年 3 月 26 日至今任汇添富中证医药卫生交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2019 年 4 月 15 日至 2022 年 6 月 13 日任中证银行交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2019 年 10 月 8 日至今任中证 800 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 2 月 1 日至今任汇添富国证生物医药交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 6 月 3 日至今任汇添富中证新能源汽车产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 9 月 29 日至 2023 年 5 月 18 日任汇添</p>
--	--	--	--	--

				<p>富中证 800 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2022 年 2 月 28 日至 2022 年 10 月 31 日任汇添富国证生物医药交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2022 年 8 月 15 日至今任汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。2022 年 9 月 26 日至今任汇添富中证中药交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 10 月 20 日至今任汇添富中证 100 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 12 月 2 日至今任汇添富中证中药交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）的基金经理。2023 年 3 月 14 日至今任汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（QDII）的基金</p>
--	--	--	--	--

					经理。2023 年 3 月 30 日至今任汇添富纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。
--	--	--	--	--	---

注:1、基金的首任基金经理,其“任职日期”为基金合同生效日,其“离任日期”为根据公司决议确定的解聘日期;

2、非首任基金经理,其“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决议确定的聘任日期和解聘日期;

3、证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注:截至本报告期末,本基金的基金经理不存在兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

#### 4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的成员简介

注:本基金无境外投资顾问。

#### 4.3 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和本基金合同的约定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益。本基金无重大违法、违规行为,本基金投资运作符合有关法规及基金合同的约定。

#### 4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.4.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人通过建立事前、事中和事后全程嵌入式的管控模式,确保公平交易制度的执行和实现。具体情况如下:

一、本基金管理人建立了内部公平交易管理规范 and 流程,以确保公平交易管控覆盖公司所有业务类型、投资策略、投资品种及投资管理的各个环节。

二、本着“时间优先、价格优先”的原则,对同一证券有相同交易需求的投资组合采用交易系统内的公平交易模块,实现事中交易执行层面的公平管控。

三、对不同投资组合进行同向交易价差分析,具体方法为:在不同时间窗口(日内、3日内、5日内)下,对不同组合同一证券同向交易的平均价差率进行 T 检验。对于未通过 T

检验的交易，再根据同向交易占优比、交易价格、交易频率、交易数量和交易时间等进行具体分析，进一步判断是否存在重大利益输送的可能性。

四、对于反向交易，根据交易顺序、交易时间窗口跨度、交易价格、交易数量占市场成交量比值、组合规模、市场收益率变化等综合判断交易是否涉及利益输送。

综上，本基金管理人通过事前的制度规范、事中的监控和事后的分析评估，严格执行了公平交易制度，公平对待了旗下各投资组合。本报告期内，未出现违反公平交易制度的情况。

#### 4.4.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未出现异常交易的情况。

本报告期内，本基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况有 25 次，投资组合因投资策略与其他组合发生反向交易。基金管理人事前严格根据内部规定进行管控，事后对交易时点、交易数量、交易价差等多方面进行综合分析，未发现导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

#### 4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2023 年上半年，美股继续大幅上行，科技股为主的纳斯达克 100 指数 (NDX) 上涨 38.75%，大盘股指数标普 500 (SPX) 上涨 15.91%，周期制造业为主的道琼斯指数 (DJI) 上涨 3.8%，纳斯达克生物科技下跌 3.23%。上半年美元对人民币升值 3.75%，对本基金（人民币计价）净值有一定额外贡献。

上半年美国通胀回落持续，核心 CPI 回落速度仍然较慢，显示出一定的粘性，主要由于美国制造业回流带动劳动力需求和薪资增长，支撑了食品、住房、交通服务等核心 CPI 项目。在通胀缓解的背景下，美联储加息节奏如期放缓，缓解了加息对经济前景的负面冲击，权益市场表现积极。此前市场一致预期的美国经济衰退从数据上看并没有得到明显验证，经济增长速度也依然达到 1.8%，和 2022 年上半年相比没有明显变化。分结构来看，制造业 PMI 维持在收缩区间、有所走弱，但服务业消费持续修复有效的支撑了 PMI，成为劳动力市场和经济增长的主要缓冲垫。

海外权益资产表现总体基于市场对企业盈利及经济前景的预期。与此同时，美国科技企业从去年末开始带动起来的人工智能 AI 技术突破浪潮也是今年上半年美股大幅上涨的主要原因之一，如果除去人工智能相关股票的涨幅，美股表现也较一般。

驱动生物科技公司股价的因素，主要是医药行业融资并购金额及其边际变化、医药新技术突破的进展。投融资链条的畅通、技术并购的频繁，可以使得生物科技企业“研发-融资

-研发”成为正向循环。2022 年下半年以来，纳斯达克生物科技指数成份股中有多家公司出现并购重组行为，且多为大型制药企业收购中小型生物创新技术企业，表明全球医药投融资情绪逐渐好转。2023 年上半年，融资并购速度稍弱于 2022 年下半年，使得整体情绪趋弱。

作为被动投资的指数基金，本基金在投资运作上严格遵守基金合同，坚持既定的投资策略，积极采取有效方法控制基金相对业绩比较基准的跟踪误差，实现投资目标。

#### 4.5.2 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期基金份额净值增长率为 0.45%。同期业绩比较基准收益率为 0.40%。

#### 4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2023 年下半年，我们需要关注海外通胀的持续性、海外利率水平维持的时间和高度。虽然目前数据上看不到美国经济硬着陆的风险，利率有较大概率维持高位，但如果经济衰退指标显现，通胀回到政策目标范围内，那么无风险利率水平或将早于市场预期开始下调。在此情境下，成长股的投资将更加有利。

海外生物科技研发活动活跃，从治疗领域看，抗肿瘤药、免疫系统药、神经系统药、感染性疾病药占比最高；按技术平台分，单抗、重组蛋白、细胞治疗、基因治疗占比最高。未来大品种方向，市场较乐观期待在阿尔兹海默症治疗领域诞生。在历史上，大品种生物科技产品的突破，也都给指数带来了较持续的一轮行情。

美股医药与 A 股医药相关性较低，和 A 股医药的商业模式、投资逻辑有差异性，纳指生物科技可以作为 A 股医药投资的有效补充，降低组合风险。同时，纳指生物科技属于当下美股里尚未有所表现的成长板块，在降息环境下有受益空间。

作为被动投资的指数基金，本基金在投资运作上严格遵守基金合同，坚持既定的投资策略，积极采取有效方法控制基金相对业绩比较基准的跟踪误差，实现投资目标。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值，并保持估值政策和程序的一贯性。

本基金管理人设有估值委员会，估值委员会负责构建估值决策体系、适时更新估值相关制度、指导并监督各类投资品种的估值程序。估值委员会由投资、研究、集中交易、合规稽核、风险管理、基金营运等部门中具有丰富从业经验和专业胜任能力的员工担任，且互相不存在直接的重大利益冲突。基金经理可参与估值委员会对于估值方法的讨论，但无最终决策权，从而将其影响程度进行适当限制，保证基金估值的公平、合理。

基金日常估值由本基金管理人同本基金托管人一同进行，基金份额净值由管理人完成估值后，经托管人复核无误后由管理人对外公布。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金《基金合同》约定：本基金收益分配采用现金分红；每一基金份额享有同等分配权；本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值。

本基金本报告期内未进行收益分配。

#### 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

#### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

#### 5.3 托管人对中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

### § 6 半年度财务会计报告（未经审计）



## 6.1 资产负债表

会计主体：汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）

报告截止日：2023 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2023 年 06 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资 产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	4,435,383.72	1,710,875.28
结算备付金		1,027.62	10,831.34
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	100,172,227.68	74,872,881.23
其中：股票投资		100,172,227.68	74,872,881.23
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		104,608,639.02	76,594,587.85
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023 年 06 月 30 日</b>	<b>上年度末 2022 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		3,934,251.95	1,092,619.14
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		36,737.49	32,324.84
应付托管费		11,021.21	9,697.45
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-

应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.7	111,987.07	120,000.00
负债合计		4,093,997.72	1,254,641.43
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.8	93,072,120.00	70,072,120.00
未分配利润	6.4.7.9	7,442,521.30	5,267,826.42
净资产合计		100,514,641.30	75,339,946.42
负债和净资产总计		104,608,639.02	76,594,587.85

注：1、报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.0800 元，基金份额总额 93,072,120.00 份。

2、本基金合同于 2022 年 08 月 15 日生效，上年度实际报告期间为 2022 年 08 月 15 日至 2022 年 12 月 31 日，特此说明。

## 6.2 利润表

会计主体：汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）

本报告期：2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		<b>1,625,868.64</b>
1. 利息收入		19,611.18
其中：存款利息收入	6.4.7.10	19,611.18
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		1,748,624.59
其中：股票投资收益	6.4.7.11	1,455,178.85
基金投资收益	6.4.7.12	-
债券投资收益	6.4.7.13	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-
股利收益	6.4.7.17	293,445.74
以摊余成本计量的金融资产 终止确认产生的收益		-
其他投资收益		-

3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-143,510.11
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-45,385.81
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	46,528.79
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>352,152.13</b>
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	211,307.02
2. 托管费	6.4.10.2.2	63,392.08
3. 销售服务费		-
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 信用减值损失	6.4.7.20	-
7. 税金及附加		-
8. 其他费用	6.4.7.21	77,453.03
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>1,273,716.51</b>
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>1,273,716.51</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		<b>-</b>
<b>六、综合收益总额</b>		<b>1,273,716.51</b>

注：本基金合同于 2022 年 08 月 15 日生效，本报无上年度可比期间，特此说明。

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）

本报告期：2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	70,072,120.00	5,267,826.42	75,339,946.42
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	70,072,120.00	5,267,826.42	75,339,946.42
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	23,000,000.00	2,174,694.88	25,174,694.88
（一）、综合收益总额	-	1,273,716.51	1,273,716.51
（二）、本期基金份额交易产生的	23,000,000.00	900,978.37	23,900,978.37

基金净值变动数 (净值减少以 “-”号填列)			
其中: 1. 基金申 购款	76,000,000.00	4,340,420.97	80,340,420.97
2. 基金赎回款	-53,000,000.00	-3,439,442.60	-56,439,442.60
(三)、本期向基 金份额持有人分 配利润产生的基 金净值变动(净 值减少以“-”号 填列)	-	-	-
四、本期末净 资产(基金净值)	93,072,120.00	7,442,521.30	100,514,641.30

注: 本基金合同于 2022 年 08 月 15 日生效, 本报无上年度可比期间, 特此说明。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

<u>张晖</u>	<u>李骁</u>	<u>雷青松</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金(QDII)(以下简称“本基金”), 系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2021]3806号《关于准予汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金(QDII)注册的批复》准予注册, 由汇添富基金管理股份有限公司向社会公开募集。基金合同于 2022 年 8 月 15 日生效。首次设立基金募集规模为 282,072,120.00 份基金份额, 业经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)出具安永华明(2022)验字第 60466941\_B43 号验资报告予以验证。本基金为交易型开放式, 存续期限不定。本基金的基金管理人为汇添富基金管理股份有限公司, 注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司, 基金托管人为中国银行股份有限公司, 境外托管人为布朗兄弟哈里曼银行。

本基金的标的指数为纳斯达克生物科技指数及其未来可能发生的变更。本基金投资于标的指数的成份股、备选成份股。此外, 本基金还可投资于以下金融产品或工具: 针对境外投资, 本基金可投资于银行存款、可转让存单、银行承兑汇票、银行票据、商业票据、回购协

议、短期政府债券等货币市场工具；政府债券、公司债券、可转换债券、住房按揭支持证券、资产支持证券等及经中国证监会认可的国际金融组织发行的证券；已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券市场挂牌交易的普通股、优先股、全球存托凭证、房地产信托凭证；在已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的公募基金；与固定收益、股权、信用、商品指数、基金等标的物挂钩的结构化投资产品；远期合约、互换及经中国证监会认可的境外交易所上市交易的权证、期权、期货等金融衍生产品以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金可以进行境外证券借贷交易、境外正回购交易、逆回购交易。有关证券借贷交易的内容以专门签署的三方或多方协议约定为准。其中，对于非成份股、备选成份股的投资部分，本基金若投资于香港市场的，可通过合格境内机构投资者（QDII）境外投资额度或内地与香港股票市场交易互联互通机制进行投资。针对境内投资，本基金可投资于国内依法发行上市的股票、债券等金融工具，具体包括：股票（包含主板、创业板、其他依法上市的股票、存托凭证），股指期货，国债期货，股票期权等，债券（国债、金融债、企业（公司）债、次级债、可交换债券、可转换债券（含分离交易可转债）、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具等资产以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金将根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不得低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。如法律法规或监管机构变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本基金紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金的业绩比较基准为：经人民币汇率调整的纳斯达克生物科技指数收益率。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与

格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2023 年 06 月 30 日的财务状况以及 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日的经营成果和净值变动情况。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，本基金的基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税

行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对本基金在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从本基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；

根据《中华人民共和国城市维护建设税法》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂免征增值税和企业所得税；

基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂未征收个人所得税和企业所得税。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 06 月 30 日
活期存款	4,435,383.72
等于：本金	4,435,295.92
加：应计利息	87.80
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
合计	4,435,383.72

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 06 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	98,515,143.19	-	100,172,227.68	1,657,084.49

贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	境外 OTC 市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	98,515,143.19	-	100,172,227.68	1,657,084.49

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

#### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

### 6.4.7.5 债权投资

#### 6.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本报告期末无债权投资。

#### 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期内不存在债权投资减值准备计提情况。

### 6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产余额。

### 6.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-



应付利息	-
应付审计费	72,315.49
应付信息披露费	39,671.58
应付指数使用费	-
应付账户维护费	-
应付汇划费	-
应付上市费	-
应付持有人大会费-公证费	-
应付持有人大会费-律师费	-
其他	-
合计	111,987.07

#### 6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	70,072,120.00	70,072,120.00
本期申购	76,000,000.00	76,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-53,000,000.00	-53,000,000.00
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	93,072,120.00	93,072,120.00

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	546,044.54	4,721,781.88	5,267,826.42
本期利润	1,417,226.62	-143,510.11	1,273,716.51
本期基金份额交易产生的变动数	379,887.80	521,090.57	900,978.37
其中：基金申购款	1,005,103.37	3,335,317.60	4,340,420.97
基金赎回款	-625,215.57	-2,814,227.03	-3,439,442.60
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,343,158.96	5,099,362.34	7,442,521.30

## 6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
活期存款利息收入	19,588.84
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	22.34
其他	-
合计	19,611.18

注：“其他”为直销申购款利息收入和结算保证金利息收入。

## 6.4.7.11 股票投资收益

## 6.4.7.11.1 股票投资收益——股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	1,455,178.85
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	1,455,178.85

## 6.4.7.11.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
卖出股票成交总额	53,915,358.33
减：卖出股票成本总额	52,403,223.38
减：交易费用	56,956.10
买卖股票差价收入	1,455,178.85

## 6.4.7.12 基金投资收益

注：本基金本报告期无基金投资收益。

## 6.4.7.13 债券投资收益

## 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

注：本基金本报告期无债券投资收益。

## 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金本报告期无买卖债券差价收入。

#### 6.4.7.14 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.14.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

##### 6.4.7.14.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期无买卖资产支持证券差价收入。

#### 6.4.7.15 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.16 衍生工具收益

##### 6.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无买卖权证差价收入。

##### 6.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期无衍生工具其他投资收益。

#### 6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
股票投资产生的股利收益	293,445.74
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	293,445.74

#### 6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
1. 交易性金融资产	-143,510.11
——股票投资	-143,510.11
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
——期货投资	-

3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-143,510.11

#### 6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	46,528.79
其他	-
合计	46,528.79

#### 6.4.7.20 信用减值损失

注：本基金本报告期无信用减值损失。

#### 6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
审计费用	22,315.49
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
账户维护费	-
银行费用	14,265.42
指数使用费	-
持有人大会-公证费	-
持有人大会-律师费	-
开户费	-
上市费	-
其他	1,200.54
合计	77,453.03

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大或有事项。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内未发生与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
汇添富基金管理股份有限公司	基金管理人, 基金销售机构
中国银行股份有限公司 (“中国银行”)	基金托管人
布朗兄弟哈里曼银行 (Brown Brothers Harriman & Co.) (“布朗兄弟”)	境外资产托管人
汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金 (QDII)	该基金是本基金的联接基金

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。

###### 6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。

###### 6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

###### 6.4.10.1.4 基金交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行基金交易。

###### 6.4.10.1.5 权证交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

###### 6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期不存在向关联方支付佣金的情况。

##### 6.4.10.2 关联方报酬

#### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	211,307.02
其中：支付销售机构的客户维护费	15,514.81

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.50% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，由基金托管人根据基金管理人指令或者双方约定的方式，在次月初五个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付。若遇法定节假日、公休日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、公休日结束之日起 5 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 5 个工作日内支付。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	63,392.08

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.15% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，由基金托管人根据基金管理人指令或者双方约定的方式，在次月初五个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付。若遇法定节假日、公休日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、公休日结束之日起 5 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 5 个工作日内支付。

上述“一、基金费用的种类”中第 3—14 项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

注：本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

注：本基金本报告期末与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

##### 6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

注：本基金本报告期末与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金的基金管理人本报告期末运用固有资金投资本基金。

##### 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2023 年 06 月 30 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例 (%)	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例 (%)
汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金 (QDII)	33,706,800.00	36.22	-	-

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金相关的费用符合基金招募说明书和相关公告的规定。

##### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
中国银行	2,681,451.56	3,446.77

布朗兄弟	1,753,932.16	16,142.07
------	--------------	-----------

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期末未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

##### 6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期末未进行利润分配。于资产负债表日之后、财务报表批准日之前批准、公告或实施的利润分配情况详见资产负债表日后事项章节。

#### 6.4.12 期末（2023 年 06 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：截止 2023 年 6 月 30 日，本基金合计持有 BELLUS HEALTH INC (BLU.US) 1,634 股。于 2023 年 6 月 29 日，BELLUS HEALTH INC (BLU.US) 发布公告，纳斯达克证券交易所有限责任公司宣布，自 2022 年 6 月 28 日起，该证券不再上市。为维护基金持有人利益，根据中国证监会《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、中国证券业协会基金估值工作小组《关于停牌股票估值的参考方法》的规定，依据 BELLUS HEALTH INC 公开披露的信息，汇添富基金管理股份有限公司与基金托管人协商一致，将汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）所持有 BELLUS HEALTH INC (BLU.US) 按每股 14.74 美元估值。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末 2023 年 06 月 30 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：截至本报告期末 2023 年 06 月 30 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

##### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券



注：截至本报告期末 2023 年 06 月 30 日止，本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了董事会、经营管理层、风险管理部门、各职能部门四级风险管理组织架构，并明确了相应的风险管理职能。

##### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金持有同一机构（政府、国际金融组织除外）发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%。此外，基金持有与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录国家或地区以外的其他国家或地区证券市场挂牌交易的证券资产不得超过基金资产净值的 10%，其中持有任一国家或地区市场的证券资产不得超过基金资产净值的 3%。本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，申购交易均通过具有基金销售资格的金融机构进行。另外，基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

##### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

###### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基

金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

除本报告“期末本基金持有的流通受限证券”章节中所列示券种流通暂时受限制不能自由转让外，本基金本报告期末的其他资产均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 06 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月- 1 年	1-5 年	5 年 以上	不计息	合计
资产							
银行存款	4,435,383.72	-	-	-	-	-	4,435,383.72
结算备付金	1,027.62	-	-	-	-	-	1,027.62

存出 保证金	-	-	-	-	-	-	-
交易 性金 融资 产	-	-	-	-	-	100,172,227.68	100,172,227.68
衍生 金融 资产	-	-	-	-	-	-	-
买入 返售 金融 资产	-	-	-	-	-	-	-
债权 投资	-	-	-	-	-	-	-
应收 清算 款	-	-	-	-	-	-	-
应收 股利	-	-	-	-	-	-	-
应收 申购 款	-	-	-	-	-	-	-
递延 所得 税资 产	-	-	-	-	-	-	-
其他 资产	-	-	-	-	-	-	-
资产 总计	4,436,411.34	-	-	-	-	100,172,227.68	104,608,639.02
负债							
短期 借款	-	-	-	-	-	-	-
交易 性金 融负 债	-	-	-	-	-	-	-
衍生 金融 负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出 回购	-	-	-	-	-	-	-

金融资产款							
应付清算款	-	-	-	-	-	3,934,251.95	3,934,251.95
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	36,737.49	36,737.49
应付托管费	-	-	-	-	-	11,021.21	11,021.21
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	111,987.07	111,987.07
负债总计	-	-	-	-	-	4,093,997.72	4,093,997.72
利率敏感度缺口	4,436,411.34	-	-	-	-	96,078,229.96	100,514,641.30
上年度末2022年12	1个月以内	1-3个月	3个月-1	1-5年	5年以上	不计息	合计

月 31 日			年				
资产							
银行存款	1,710,875.28	-	-	-	-	-	1,710,875.28
结算备付金	10,831.34	-	-	-	-	-	10,831.34
存出保证金	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	-	-	74,872,881.23	74,872,881.23
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	1,721,706.62	-	-	-	-	74,872,881.23	76,594,587.85
负债							
短期借款	-	-	-	-	-	-	-
交易	-	-	-	-	-	-	-

性金融负债							
衍生金融负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-	1,092,619.14	1,092,619.14
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	32,324.84	32,324.84
应付托管费	-	-	-	-	-	9,697.45	9,697.45
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	120,000.00	120,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	1,254,641.43	1,254,641.43

利率敏感程度缺口	1,721,706.62	-	-	-	-	73,618,239.80	75,339,946.42
----------	--------------	---	---	---	---	---------------	---------------

表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期末未持有债券资产及资产支持证券（不含可转换债券及可交换债券），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 06 月 30 日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产				
银行存款	1,753,982.31	-	-	1,753,982.31
结算备付金	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资产	100,172,227.68	-	-	100,172,227.68
衍生金融资产	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-
应收申购	-	-	-	-

款				
递延所得税资产	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产合计	101,926,209.99	-	-	101,926,209.99
以外币计价的负债				
短期借款	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-
应付清算款	1,678,504.42	-	-	1,678,504.42
应付赎回款	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-
应付托管费	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-
负债合计	1,678,504.42	-	-	1,678,504.42
资产负债表外汇风险敞口净额	100,247,705.57	-	-	100,247,705.57
	上年度末 2022 年 12 月 31 日			
项目	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产				



银行存款	195,735.00	-	-	195,735.00
结算备付金	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资产	74,872,881.23	-	-	74,872,881.23
衍生金融资产	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产合计	75,068,616.23	-	-	75,068,616.23
以外币计价的负债				
短期借款	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-
应付清算款	4,322.93	-	-	4,322.93
应付赎回款	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-
应付托管费	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-

应交税费	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-
负债合计	4,322.93	-	-	4,322.93
资产负债表外外汇风险敞口净额	75,064,293.30	-	-	75,064,293.30

#### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	1. 除汇率以外的其他市场变量保持不变，且未考虑基金管理人为降低汇率风险而可能采取的风险管理活动。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2023 年 06 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	美元相对人民币升值 5%	5,012,385.28	3,753,214.67
	美元相对人民币贬值 5%	-5,012,385.28	-3,753,214.67

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指交易性金融资产的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险。本基金的金融资产以公允价值计量，所有市场价格因素引起的金融资产公允价值变动均直接反映在当期损益中。

本基金管理人通过标准差、跟踪误差、beta 值等指标监控投资组合面临的市场价格波动风险。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 06 月 30 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	100,172,227.68	99.66	74,872,881.23	99.38
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-

交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	100,172,227.68	99.66	74,872,881.23	99.38

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1. 本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即从长期来看，本基金所投资的证券与业绩比较基准的变动呈线性相关，且报告期内的相关系数在资产负债表日后短期内保持不变； 2. 以下分析中，除市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2023 年 06 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	纳斯达克生物科技指数（汇率调整）上涨 5%	4,826,742.72	3,547,018.18
纳斯达克生物科技指数（汇率调整）下跌 5%	-4,826,742.72	-3,547,018.18	

注：本基金管理人运用资本—资产定价模型方法对本基金的市场价格风险进行分析。上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券市场组合的价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 06 月 30 日
第一层次	99,998,193.13
第二层次	174,034.55
第三层次	-
合计	100,172,227.68

#### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。对于公开市场交易的股票、债券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发售等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	100,172,227.68	95.76

	其中：普通股	89,335,591.29	85.40
	存托凭证	10,836,636.39	10.36
	优先股	-	-
	房地产信托	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	4,436,411.34	4.24
8	其他各项资产	-	-
9	合计	104,608,639.02	100.00

## 7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
美国	100,172,227.68	99.66
合计	100,172,227.68	99.66

注：按公允价值占基金资产净值比例从大到小排序；国家（地区）类别根据其所在的证券交易所确定；此处股票包括普通股和优先股；ADR、GDR 按照存托凭证本身挂牌的证券交易所确定。

## 7.3 期末按行业分类的权益投资组合

### 7.3.1 期末指数投资按行业分类的权益投资组合

行业类别	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
10 能源	-	-
15 原材料	-	-
20 工业	-	-
25 可选消费	-	-

30 日常消费	-	-
35 医疗保健	99,998,193.13	99.49
40 金融	-	-
45 信息技术	-	-
50 电信服务	-	-
55 公用事业	-	-
60 房地产	-	-
合计	99,998,193.13	99.49

### 7.3.2 期末积极投资按行业分类的权益投资组合

行业类别	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
10 能源	-	-
15 原材料	-	-
20 工业	-	-
25 可选消费	-	-
30 日常消费	-	-
35 医疗保健	174,034.55	0.17
40 金融	-	-
45 信息技术	-	-
50 电信服务	-	-
55 公用事业	-	-
60 房地产	-	-
合计	174,034.55	0.17

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

### 7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的权益投资明细

#### 7.4.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	公司名称（中文）	证券代码	所在证券市场	所属国家（地区）	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	Vertex Pharmaceuticals	福泰制药	VRTX	纳斯达克	美国	3,371	8,571,884.24	8.53

	Inc		US	达 克 证 券 交 易 所				
2	Amgen Inc	安进公司	AMG N US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	5,065	8,125,638. 27	8.08
3	Gilead Sciences Inc	吉利德科学	GIL D US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	14,526	8,089,419. 09	8.05
4	Regeneron Pharmaceuticals Inc	再生元制药股份有限公司	REG N US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	1,412	7,331,141. 18	7.29
5	Moderna Inc	莫德纳公司	MRN A US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	4,990	4,380,894. 15	4.36
6	AstraZeneca PLC	阿斯利康公	AZN	纳	美	7,646	3,954,132.	3.93

		共有限公司	US	斯达克证 券交易 所	国		77	
7	Biogen Inc	渤健公司	BII B US	纳斯 达克 证 券 交 易 所	美 国	1,885	3,879,837. 31	3.86
8	Seagen Inc	Seagen 股 份 有 限 公 司	SGE N US	纳斯 达克 证 券 交 易 所	美 国	2,457	3,416,894. 54	3.40
9	Illumina Inc	Illumina 公 司	ILM N US	纳斯 达克 证 券 交 易 所	美 国	2,072	2,807,073. 58	2.79
10	Alnylam Pharmaceuticals Inc	Alnylam 制 药股 份有 限公 司	ALN Y US	纳斯 达克 证 券 交 易 所	美 国	1,633	2,241,240. 98	2.23



11	Horizon Therapeutics Plc	Horizon Therapeuti c 公共有限 公司	HZN P US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	2,996	2,226,547. 90	2.22
12	BioMarin Pharmaceutical Inc	拜玛林制药	BMR N US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	2,461	1,541,403. 90	1.53
13	Sanofi	赛诺菲	SNY US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	3,917	1,525,556. 42	1.52
14	Incyte Corp	因赛特公司	INC Y US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	2,925	1,315,682. 70	1.31
15	Royalty Pharma PLC	Royalty Pharma 公司	RPR X US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	5,874	1,304,739. 29	1.30

				所				
16	Viatrix Inc	晖致	VTR S US	纳斯达克证 券交易 所	美国	15,715	1,133,263.40	1.13
17	Argenx SE	Argenx 公司	ARG X US	纳斯达克证 券交易 所	美国	391	1,101,099.41	1.10
18	Sarepta Therapeutics Inc	Sarepta 治 疗股份有 限公司	SRP T US	纳斯达克证 券交易 所	美国	1,221	1,010,375.81	1.01
19	Apellis Pharmaceuticals Inc	Apellis 制 药公司	APL S US	纳斯达克证 券交易 所	美国	1,526	1,004,520.60	1.00
20	United Therapeutics Corp	联合治疗公 司	UTH R US	纳斯达克证 券交	美国	615	980,983.64	0.98

				易所				
21	BioNTech SE	BioNTech 公司	BNT X US	纳斯达克 克证 券交 易所	美国	1,226	956,133.61	0.95
22	Neurocrine Biosciences Inc	Neurocrine 生物科学股 份有限公司	NBI X US	纳斯达克 克证 券交 易所	美国	1,279	871,501.57	0.87
23	Karuna Therapeutics Inc	-	KRT X US	纳斯达克 克证 券交 易所	美国	490	767,788.22	0.76
24	Jazz Pharmaceuticals PLC	爵士制药公 司	JAZ Z US	纳斯达克 克证 券交 易所	美国	839	751,561.46	0.75
25	Roivant Sciences Ltd	-	ROI V US	纳斯达克 克证 券	美国	9,941	724,063.31	0.72

				交易所				
26	BeiGene Ltd	百济神州	BGN E US	纳斯达克 证 券 交 易 所	美国	542	698,291.20	0.69
27	Medpace Holdings Inc	Medpace 控 股 股 份 有 限 公 司	MED P US	纳斯达克 证 券 交 易 所	美国	399	692,432.73	0.69
28	Exelixis Inc	Exelixis 股 份 有 限 公 司	EXE L US	纳斯达克 证 券 交 易 所	美国	4,268	589,346.94	0.59
29	Intra-Cellular Therapies Inc	Intra- Cellular Therapies 公 司	ITC I US	纳斯达克 证 券 交 易 所	美国	1,258	575,582.37	0.57
30	Ionis Pharmaceuticals Inc	Ionis 制 药 股 份 有 限 公 司	ION S US	纳斯达克 证 券 交 易 所	美国	1,875	555,889.83	0.55

				券交易所				
31	Abcam PLC	Abcam 公共有限公司	ABC M US	纳斯达克证 券交易所	美国	2,952	521,958.84	0.52
32	IVERIC bio Inc	IVERIC 生物公司	ISE E US	纳斯达克证 券交易所	美国	1,805	513,094.66	0.51
33	Alkermes PLC	Alkermes 公 共有限公司	ALK S US	纳斯达克证 券交易所	美国	2,177	492,366.73	0.49
34	Ascendis Pharma A/S	Ascendis 制 药股份有限 公司	ASN D US	纳斯达克证 券交易所	美国	748	482,387.18	0.48
35	ImmunoGen Inc	英基股份有 限公司	IMG N US	纳斯达克	美国	3,355	457,457.09	0.46

				证 券 交 易 所				
36	Halozyme Therapeutics Inc	Halozyme Therapeuti cs 股份有限 公司	HAL O US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	1,726	449,855.33	0.45
37	Vaxcyte Inc	-	PCV X US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	1,228	443,131.72	0.44
38	Legend Biotech Corp	传奇生物科 技公司	LEG N US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	849	423,478.63	0.42
39	CRISPR Therapeutics AG	CRISPR 治疗 股份公司	CRS P US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	1,034	419,448.73	0.42
40	Novocure Ltd	Novocure 有 限公司	NVC R US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	1,392	417,420.01	0.42

				克 证 券 交 易 所				
41	Syneos Health Inc	Syneos 健康公司	SYN H US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	1,359	413,808.99	0.41
42	Madrigal Pharmaceuticals Inc	Madrigal 制药有限公司	MDG L US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	240	400,598.35	0.40
43	Guardant Health Inc	Guardant Health 股份有限公司	GH US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	1,535	397,079.39	0.40
44	Denali Therapeutics Inc	-	DNL I US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	1,794	382,540.64	0.38
45	ACADIA Pharmaceuticals	ACADIA 制药股份有限公司	ACA D	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	2,132	368,959.46	0.37

	Inc	司	US	达 克 证 券 交 易 所				
46	Blueprint Medicines Corp	Blueprint 医药股份有 限公司	BPM C US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	793	362,139.75	0.36
47	Arrowhead Pharmaceuticals Inc	Arrowhead 制药股份有 限公司	ARW R US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	1,401	360,998.51	0.36
48	Prothena Corp PLC	Prothena 公 共有限公司	PRT A US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	691	340,923.94	0.34
49	Intellia Therapeutics Inc	Intellia Therapeuti cs 股份有限 公司	NTL A US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	1,155	340,341.68	0.34
50	Amicus	Amicus	FOL	纳	美	3,730	338,520.06	0.34



	Therapeutics Inc	Therapeutics 股份有限公司	D US	纳斯达克证 券交易所	美国			
51	Reata Pharmaceuticals Inc	Reata 制药 股份有限公司	RETA US	纳斯达克证 券交易所	美国	433	319,009.53	0.32
52	Pacific Biosciences of California Inc	加州太平洋 生物科学股 份有限公司	PACB US	纳斯达克证 券交易所	美国	3,275	314,737.78	0.31
53	Vir Biotechnology Inc	-	VIR US	纳斯达克证 券交易所	美国	1,756	311,249.02	0.31
54	Ultragenyx Pharmaceutical Inc	Ultragenyx 制药股份有 限公司	RARE US	纳斯达克证 券交易所	美国	928	309,326.67	0.31

55	Axsome Therapeutics Inc	Axsome 医疗股份有限公司	AXSMUS	纳斯达克证券交易所	美国	571	296,489.46	0.29
56	Cytokinetics Inc	Cytokinetics 股份有限公司	CYTKUS	纳斯达克证券交易所	美国	1,254	295,574.82	0.29
57	Krystal Biotech Inc	-	KRYSUS	纳斯达克证券交易所	美国	339	287,576.72	0.29
58	PTC Therapeutics Inc	PTC 治疗股份有限公司	PTCTUS	纳斯达克证券交易所	美国	972	285,644.83	0.28
59	Insmed Inc	Insmed 股份有限公司	INSMUS	纳斯达克证券交易所	美国	1,788	272,606.31	0.27

				所				
60	REVOLUTION Medicines Inc	-	RVM D US	纳斯达克 证 券 交 易 所	美国	1,393	269,253.18	0.27
61	Sage Therapeutics Inc	Sage Therapeuti cs 公司	SAG E US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	783	266,029.82	0.26
62	Amphastar Pharmaceuticals Inc	Amphastar 制药公司	AMP H US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	633	262,863.84	0.26
63	Bridgebio Pharma Inc	-	BBI O US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	2,104	261,493.03	0.26
64	Morphic Holding Inc	-	MOR F US	纳 斯 达 克 证 券 交	美国	600	248,553.07	0.25

				易所				
65	Akero Therapeutics Inc	-	AKROUS	纳斯达克证券交易所	美国	725	244,595.14	0.24
66	Chinook Therapeutics Inc	Chinook 治疗股份有限公司	KDNYUS	纳斯达克证券交易所	美国	876	243,190.95	0.24
67	Immunovant Inc	-	IMVTUS	纳斯达克证券交易所	美国	1,709	234,258.49	0.23
68	Xenon Pharmaceuticals Inc	Xenon 制药股份有限公司	XENEUS	纳斯达克证券交易所	美国	833	231,735.02	0.23
69	Beam Therapeutics Inc	-	BEAMUS	纳斯达克证券交易所	美国	999	230,489.07	0.23

				交易所				
70	CureVac NV	-	CVA C US	纳斯达克 证 券 交 易 所	美国	2,934	220,909.18	0.22
71	DICE Therapeutics Inc	-	DIC E US	纳斯达克 证 券 交 易 所	美国	626	210,154.88	0.21
72	Nuvalent Inc	-	NUV L US	纳斯达克 证 券 交 易 所	美国	673	205,071.17	0.20
73	Revance Therapeutics Inc	Revance Therapeuti cs 股份有 限公司	RVN C US	纳斯达克 证 券 交 易 所	美国	1,102	201,539.27	0.20
74	Harmony Biosciences Holdings Inc	-	HRM Y US	纳斯达克 证 券 交 易 所	美国	785	199,606.58	0.20

				券交易所				
75	Mirati Therapeutics Inc	Mirati 治疗公司	MRT X US	纳斯达克证券交易所	美国	762	198,933.93	0.20
76	Ventyx Biosciences Inc	-	VTY X US	纳斯达克证券交易所	美国	767	181,783.79	0.18
77	Myriad Genetics Inc	米利亚德基因公司	MYG N US	纳斯达克证券交易所	美国	1,069	179,051.13	0.18
78	Immunocore Holdings PLC	-	IMC R US	纳斯达克证券交易所	美国	410	177,636.18	0.18
79	AbCellera Biologics Inc	-	ABC L US	纳斯达克	美国	3,785	176,678.76	0.18

				证 券 交 易 所				
80	Veracyte Inc	Veracyte 股 份有限公司	VCY T US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	949	174,655.03	0.17
81	Pacira BioSciences Inc	Pacira 生 物 科 学 股 份 有 限 公 司	PCR X US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	602	174,301.76	0.17
82	Summit Therapeutics Inc	-	SMM T US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	9,145	165,860.65	0.17
83	Zai Lab Ltd	再鼎医药	ZLA B US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	814	163,102.35	0.16
84	Zentalis Pharmaceuticals Inc	-	ZNT L US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	779	158,791.22	0.16

				克 证 券 交 易 所				
85	Genmab A/S	Genmab 股份 有限公司	GMA B US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	577	158,474.58	0.16
86	Ironwood Pharmaceuticals Inc	Ironwood 制 药股份有限 公司	IRW D US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	2,036	156,532.79	0.16
87	SpringWorks Therapeutics Inc	-	SWT X US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	820	155,357.59	0.15
88	Maravai LifeSciences Holdings Inc	Maravai LifeScienc es 控股股份 有限公司	MRV I US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	1,729	155,293.06	0.15
89	Supernus Pharmaceuticals	Supernus 制 药股份有限	SUP N	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	714	155,086.19	0.15



	Inc	公司	US	达 克 证 券 交 易 所				
90	Geron Corp	杰龙公司	GER N US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	6,669	154,686.24	0.15
91	Rocket Pharmaceuticals Inc	Rocket 制药 公司	RCK T US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	1,054	151,329.78	0.15
92	Protagonist Therapeutics Inc	-	PTG X US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	750	149,682.45	0.15
93	Iovance Biotherapeutics Inc	Iovance 生 物医疗股份 有限公司	IOV A US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	2,942	149,658.46	0.15
94	Agios	Agios 制药	AGI	纳	美	729	149,178.66	0.15

	Pharmaceuticals Inc	公司	0 US	斯 达 克 证 券 交 易 所	国			
95	Relay Therapeutics Inc	-	RLA Y US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	1,594	144,665.14	0.14
96	Arcellx Inc	-	ACL X US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	629	143,713.79	0.14
97	Xencor Inc	Xencor 股份 有限公司	XNC R US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	792	142,899.15	0.14
98	Amylyx Pharmaceuticals Inc	-	AML X US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	880	137,157.25	0.14

99	Syndax Pharmaceuticals Inc	Syndax 制药股份有限公司	SNDX US	纳斯达克证券交易所	美国	902	136,414.87	0.14
100	Verona Pharma PLC	Verona 制药公共有限公司	VRNA US	纳斯达克证券交易所	美国	873	133,353.73	0.13
101	Aurinia Pharmaceuticals Inc	Aurinia 制药股份有限公司	AUPH US	纳斯达克证券交易所	美国	1,875	131,148.27	0.13
102	89bio Inc	-	ETNB US	纳斯达克证券交易所	美国	955	130,767.11	0.13
103	Recursion Pharmaceuticals Inc	-	RXR US	纳斯达克证券交易所	美国	2,420	130,623.68	0.13

				所				
104	Ideaya Biosciences Inc	-	IDY A US	纳斯达克证 券交易 所	美国	751	127,524.53	0.13
105	Replimune Group Inc	-	REP L US	纳斯达克证 券交易 所	美国	757	127,011.79	0.13
106	BioCryst Pharmaceuticals Inc	BioCrys 制 药股份有 限公司	BCR X US	纳斯达克证 券交易 所	美国	2,477	126,004.08	0.13
107	Arvinas Inc	-	ARV N US	纳斯达克证 券交易 所	美国	700	125,541.05	0.12
108	Kymera Therapeutics Inc	-	KYM R US	纳斯达克证 券交	美国	725	120,437.83	0.12

				易所				
109	Ligand Pharmaceuticals Inc	Ligand 制药股份有限公司	LGN D US	纳斯达克证券交易所	美国	226	117,741.52	0.12
110	Merus NV	Merus 公共有限责任公司	MRU S US	纳斯达克证券交易所	美国	610	116,055.74	0.12
111	ImmunityBio Inc	ImmunityBio 股份有限公司	IBR X US	纳斯达克证券交易所	美国	5,715	114,801.34	0.11
112	Keros Therapeutics Inc	-	KRO S US	纳斯达克证券交易所	美国	388	112,649.07	0.11
113	Twist Bioscience Corp	-	TWS T US	纳斯达克证券交易所	美国	749	110,732.06	0.11

				交易所				
11 4	Verve Therapeutics Inc	-	VER V US	纳斯达克 证 券 交 易 所	美国	812	110,012.81	0.11
11 5	Travere Therapeutics Inc	Travere 医 疗股份有限 公司	TVT X US	纳斯达克 证 券 交 易 所	美国	978	108,546.55	0.11
11 6	Sana Biotechnology Inc	-	SAN A US	纳斯达克 证 券 交 易 所	美国	2,510	108,095.08	0.11
11 7	Inhibrx Inc	-	INB X US	纳斯达克 证 券 交 易 所	美国	572	107,296.77	0.11
11 8	Deciphera Pharmaceuticals Inc	-	DCP H US	纳斯达克 证 券 交 易 所	美国	1,029	104,689.70	0.10

				券交易所				
119	ANI Pharmaceuticals Inc	ANI 制药股份有限公司	ANIPUS	纳斯达克证券交易所	美国	265	103,075.68	0.10
120	MannKind Corp	曼恩凯德公司	MNKDUS	纳斯达克证券交易所	美国	3,464	101,872.80	0.10
121	Pliant Therapeutics Inc	-	PLRXUS	纳斯达克证券交易所	美国	775	101,471.91	0.10
122	Cymabay Therapeutics Inc	Cymabay 医疗股份有限公司	CBAYUS	纳斯达克证券交易所	美国	1,278	101,118.57	0.10
123	Avadel Pharmaceuticals PLC	Avadel 制药公共有限公司	AVDLUS	纳斯达克	美国	844	100,504.52	0.10

				证 券 交 易 所				
12 4	Grifols SA	基立福公司	GRF S US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	1,514	100,209.13	0.10
12 5	Mirum Pharmaceuticals Inc	-	MIR M US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	498	93,091.86	0.09
12 6	Crinetics Pharmaceuticals Inc	-	CRN X US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	708	92,187.91	0.09
12 7	Adaptive Biotechnologies Corp	-	ADP T US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	1,891	91,685.36	0.09
12 8	Rhythm Pharmaceuticals Inc	-	RYT M US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	745	88,769.31	0.09



				克 证 券 交 易 所				
12 9	EQRx Inc	-	EQR X US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	6,388	85,854.64	0.09
13 0	Day One Biopharmaceutica ls Inc	-	DAW N US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	964	83,170.11	0.08
13 1	REGENXBIO Inc	REGENXBIO 股份有限公司	RGN X US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	570	82,332.93	0.08
13 2	Cogent Biosciences Inc	-	COG T US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	930	79,564.73	0.08
13 3	Innoviva Inc	Innoviva 股 份有限公司	INV A	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	858	78,922.64	0.08

			US	达 克 证 券 交 易 所				
13 4	ADMA Biologics Inc	ADMA 生物制 剂股份有限 公司	ADM A US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	2,913	77,669.91	0.08
13 5	Lyell Immunopharma Inc	-	LYE L US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	3,271	75,161.18	0.07
13 6	Avidity Biosciences Inc	-	RNA US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	928	74,364.47	0.07
13 7	Phathom Pharmaceuticals Inc	-	PHA T US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	717	74,190.47	0.07
13	Biomea Fusion	-	BME	纳	美	464	73,593.33	0.07

8	Inc		A US	斯 达 克 证 券 交 易 所	国			
13 9	Arcturus Therapeutics Holdings Inc	-	ARC T US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	348	72,118.11	0.07
14 0	4D Molecular Therapeutics Inc	-	FDM T US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	549	71,683.04	0.07
14 1	Collegium Pharmaceutical Inc	Collegium 制药股份有 限公司	COL L US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	454	70,498.23	0.07
14 2	Aclaris Therapeutics Inc	Aclaris 医 疗股份有限 公司	ACR S US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	926	69,386.61	0.07

14 3	Ardelyx Inc	Ardelyx 股份有限公司	ARD X US	纳斯达克 证 券 交 易 所	美国	2,811	68,856.74	0.07
14 4	Allogene Therapeutics Inc	-	ALL O US	纳斯达克 证 券 交 易 所	美国	1,912	68,664.18	0.07
14 5	Kura Oncology Inc	Kura 肿瘤学 股份有限公司	KUR A US	纳斯达克 证 券 交 易 所	美国	897	68,574.72	0.07
14 6	Galapagos NV	Galapagos 制药公司	GLP G US	纳斯达克 证 券 交 易 所	美国	230	67,574.24	0.07
14 7	HilleVax Inc	-	HLV X US	纳斯达克 证 券 交 易 所	美国	514	63,844.71	0.06

				所				
148	Bicycle Therapeutics PLC	-	BCY C US	纳斯达克 证 券 交 易 所	美国	339	62,512.42	0.06
149	Anavex Life Sciences Corp	Anavex 生命 科学公司	AVX L US	纳斯达克 证 券 交 易 所	美国	1,059	62,211.75	0.06
150	Dyne Therapeutics Inc	-	DYN US	纳斯达克 证 券 交 易 所	美国	764	62,105.75	0.06
151	RAPT Therapeutics Inc	-	RAP T US	纳斯达克 证 券 交 易 所	美国	450	60,805.11	0.06
152	Novavax Inc	诺瓦瓦克斯 股份有限公司	NVA X US	纳斯达克 证 券 交	美国	1,131	60,720.78	0.06

				易所				
153	ARS Pharmaceuticals Inc	-	SPRY US	纳斯达克证券交易所	美国	1,242	60,128.77	0.06
154	Seres Therapeutics Inc	Seres 医疗股份有限公司	MCRB US	纳斯达克证券交易所	美国	1,676	58,009.01	0.06
155	Theravance Biopharma Inc	Theravance 生物制药股份有限公司	TBPH US	纳斯达克证券交易所	美国	757	56,613.78	0.06
156	Arcutis Biotherapeutics Inc	-	ARQT US	纳斯达克证券交易所	美国	805	55,433.81	0.06
157	Harrow Health Inc	Imprimis 制药股份有限公司	HROW US	纳斯达克证券交易所	美国	395	54,343.80	0.05

				交易所				
158	Editas Medicine Inc	Editas 医药股份有限公司	EDITUS	纳斯达克证券交易所	美国	905	53,818.84	0.05
159	Marinus Pharmaceuticals Inc	Marinus 制药股份有限公司	MRNSUS	纳斯达克证券交易所	美国	662	51,948.59	0.05
160	uniQure NV	uniQure 股份有限公司	QUREUS	纳斯达克证券交易所	美国	624	51,671.98	0.05
161	AnaptysBio Inc	AnaptysBio 股份有限公司	ANABUS	纳斯达克证券交易所	美国	347	50,999.55	0.05
162	23andMe Holding Co	-	MEUS	纳斯达克证	美国	3,841	48,570.02	0.05

				券交易所				
163	2seventy bio Inc	-	TSV T US	纳斯达克证 券交易所	美国	658	48,116.31	0.05
164	Alector Inc	-	ALE C US	纳斯达克证 券交易所	美国	1,093	47,465.77	0.05
165	Terns Pharmaceuticals Inc	-	TER N US	纳斯达克证 券交易所	美国	743	46,976.73	0.05
166	Alpine Immune Sciences Inc	Alpine 免疫 科学股份有 限公司	ALP N US	纳斯达克证 券交易所	美国	629	46,722.89	0.05
167	Kiniksa Pharmaceuticals Ltd	-	KNS A US	纳斯达克	美国	458	46,596.58	0.05



				证 券 交 易 所				
16 8	Edgewise Therapeutics Inc	-	EWT X US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	829	46,423.96	0.05
16 9	Tarsus Pharmaceuticals Inc	-	TAR S US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	352	45,960.71	0.05
17 0	Nautilus Biotechnology Inc	-	NAU T US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	1,637	45,776.82	0.05
17 1	Nurix Therapeutics Inc	-	NRI X US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	622	44,899.53	0.04
17 2	iTeos Therapeutics Inc	-	ITO S US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	469	44,869.04	0.04

				克 证 券 交 易 所				
17 3	MaxCyte Inc	-	MXC T US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	1,351	44,807.84	0.04
17 4	Stoke Therapeutics Inc	-	STO K US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	579	44,473.14	0.04
17 5	Fate Therapeutics Inc	Fate Therapeuti cs 股份公司	FAT E US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	1,290	44,369.30	0.04
17 6	Intercept Pharmaceuticals Inc	Intercept 制药股份有 限公司	ICP T US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	547	43,714.79	0.04
17 7	Amarin Corp PLC	Amarin 公共 有限公司	AMR N	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	5,038	43,320.26	0.04

			US	达 克 证 券 交 易 所				
17 8	Enanta Pharmaceuticals Inc	Enanta 制药 公司	ENT A US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	276	42,678.47	0.04
17 9	Repare Therapeutics Inc	-	RPT X US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	552	42,199.83	0.04
18 0	PetIQ Inc	PetIQ 股份 有限公司	PET Q US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	382	41,873.08	0.04
18 1	Lexicon Pharmaceuticals Inc	Lexicon 制 药股份有限 公司	LXR X US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	2,485	41,119.50	0.04
18	Cullinan	-	CGE	纳	美	516	40,118.80	0.04

2	Oncology Inc		M US	斯 达 克 证 券 交 易 所	国			
18 3	Erasca Inc	-	ERA S US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	1,976	39,407.78	0.04
18 4	Evolus Inc	-	EOL S US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	746	39,188.55	0.04
18 5	Scholar Rock Holding Corp	-	SRR K US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	712	38,791.56	0.04
18 6	Coherus Biosciences Inc	Coherus 生 物科学公司	CHR S US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	1,233	38,043.19	0.04

187	Ocular Therapeutix Inc	Ocular Therapeutix 股份有限公司	OCUL US	纳斯达克证券交易所	美国	1,016	37,881.69	0.04
188	MeiraGTx Holdings plc	-	MGT X US	纳斯达克证券交易所	美国	779	37,826.20	0.04
189	Arbutus Biopharma Corp	Arbutus 生物制药公司	ABUS US	纳斯达克证券交易所	美国	2,177	36,180.30	0.04
190	Vanda Pharmaceuticals Inc	Vanda 制药股份有限公司	VNDA US	纳斯达克证券交易所	美国	753	35,856.37	0.04
191	Allakos Inc	-	ALLK US	纳斯达克证券交易所	美国	1,134	35,726.09	0.04

				所				
19 2	HUTCHMED China Ltd	和黄医药	HCM US	纳斯达克证 券交易 所	美国	412	35,724.36	0.04
19 3	Mersana Therapeutics Inc	-	MRS N US	纳斯达克证 券交易 所	美国	1,499	35,635.55	0.04
19 4	Castle Biosciences Inc	-	CST L US	纳斯达克证 券交易 所	美国	350	34,698.29	0.03
19 5	Generation Bio Co	-	GBI O US	纳斯达克证 券交易 所	美国	861	34,217.78	0.03
19 6	Kodiak Sciences Inc	-	KOD US	纳斯达克证 券交	美国	686	34,202.60	0.03

				易所				
197	SIGA Technologies Inc	SIGA 科技股份有限公司	SIG A US	纳斯达克 证券 交易 所	美国	934	34,081.93	0.03
198	Xeris Biopharma Holdings Inc	-	XER S US	纳斯达克 证券 交易 所	美国	1,799	34,057.94	0.03
199	WaVe Life Sciences Ltd	WaVe 生命科学有限公司	WVE US	纳斯达克 证券 交易 所	美国	1,289	33,903.16	0.03
200	Design Therapeutics Inc	-	DSG N US	纳斯达克 证券 交易 所	美国	733	33,368.02	0.03
201	Bluebird Bio Inc	Bluebird 生物股份有限公司	BLU E US	纳斯达克 证券 交易 所	美国	1,395	33,163.17	0.03

				交易所				
20 2	Omeros Corp	Omeros 公司	OMER US	纳斯达克证 券交易所	美国	824	32,390.08	0.03
20 3	Monte Rosa Therapeutics Inc	-	GLUE US	纳斯达克证 券交易所	美国	647	32,024.38	0.03
20 4	MacroGenics Inc	MacroGenic s 股份有限 公司	MGN X US	纳斯达克证 券交易所	美国	811	31,351.66	0.03
20 5	Centessa Pharmaceuticals PLC	-	CNT A US	纳斯达克证 券交易所	美国	691	30,906.84	0.03
20 6	Allovir Inc	-	ALV R US	纳斯达克证	美国	1,226	30,120.02	0.03



				券交易所				
207	Atea Pharmaceuticals Inc	-	AVIRUS	纳斯达克证券交易所	美国	1,093	29,537.77	0.03
208	Omega Therapeutics Inc	-	OMGAUS	纳斯达克证券交易所	美国	721	29,174.89	0.03
209	ALX Oncology Holdings Inc	-	ALXOUS	纳斯达克证券交易所	美国	536	29,086.45	0.03
210	Immuneering Corp	-	IMRXUS	纳斯达克证券交易所	美国	383	28,062.26	0.03
211	Humacyte Inc	-	HUMAUS	纳斯达克	美国	1,355	28,002.14	0.03

				证 券 交 易 所				
21 2	Foghorn Therapeutics Inc	-	FHT X US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	548	27,876.56	0.03
21 3	Precigen Inc	Precigen 股 份有限公司	PGE N US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	3,349	27,829.08	0.03
21 4	Tango Therapeutics Inc	-	TNG X US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	1,158	27,780.02	0.03
21 5	PMV Pharmaceuticals Inc	-	PMV P US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	600	27,140.10	0.03
21 6	ATAI Life Sciences NV	-	ATA I US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	2,175	27,031.72	0.03

				克 证 券 交 易 所				
21 7	Sutro Biopharma Inc	-	STR O US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	792	26,611.18	0.03
21 8	Phibro Animal Health Corp	辉宝动物保 健公司	PAH C US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	267	26,431.25	0.03
21 9	IGM Biosciences Inc	-	IGM S US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	387	25,810.63	0.03
22 0	FibroGen Inc	FibroGen 股 份有限公司	FGE N US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	1,279	24,952.86	0.02
22 1	Caribou Biosciences Inc	-	CRB U	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	805	24,721.27	0.02

			US	达 克 证 券 交 易 所				
22 2	Exscientia Plc	-	EXA I US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	576	24,639.40	0.02
22 3	Gracell Biotechnologies Inc	巨喜生物科 技有限公司	GRC L US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	893	24,584.56	0.02
22 4	Eagle Pharmaceuticals Inc/DE	特拉华 Eagle 制药 股份有限公 司	EGR X US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	172	24,160.76	0.02
22 5	UroGen Pharma Ltd	-	URG N US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	307	22,959.62	0.02
22	Prelude	-	PRL	纳 美	美	687	22,338.56	0.02

6	Therapeutics Inc		D US	斯 达 克 证 券 交 易 所	国			
22 7	Sangamo Therapeutics Inc	桑加莫疗法 股份有限公司	SGM O US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	2,252	21,154.25	0.02
22 8	Quantum-Si Inc	-	QSI US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	1,593	20,604.15	0.02
22 9	NGM Biopharmaceutica ls Inc	-	NGM US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	1,080	20,212.01	0.02
23 0	PepGen Inc	-	PEP G US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	311	20,090.18	0.02

23 1	I-Mab	天境生物	IMAB US	纳斯达克 证 券 交 易 所	美国	903	19,509.44	0.02
23 2	Karyopharm Therapeutics Inc	Karyopharm Therapeuti cs 股份有限 公司	KPT I US	纳斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	1,494	19,323.67	0.02
23 3	Fulcrum Therapeutics Inc	-	FUL C US	纳斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	810	19,314.56	0.02
23 4	Compass Pathways Plc	-	CMP S US	纳斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	313	18,726.67	0.02
23 5	Acumen Pharmaceuticals Inc	-	ABO S US	纳斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	538	18,698.78	0.02

				所				
23 6	NanoString Technologies Inc	NanoString 技术公司	NST G US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	621	18,173.25	0.02
23 7	Century Therapeutics Inc	-	IPS C US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	781	17,832.99	0.02
23 8	Codexis Inc	Codexis 股 份有限公司	CDX S US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	875	17,703.21	0.02
23 9	Annexon Inc	-	ANN X US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	695	17,677.20	0.02
24 0	Kezar Life Sciences Inc	-	KZR US	纳 斯 达 克 证 券 交	美 国	949	16,800.35	0.02

				易所				
24 1	Altimune Inc	Altimune 股份有限公司	ALT US	纳斯达克 证 券 交 易 所	美国	646	16,477.57	0.02
24 2	Gritstone bio Inc	-	GRT S US	纳斯达克 证 券 交 易 所	美国	1,166	16,429.30	0.02
24 3	Selecta Biosciences Inc	Selecta 生 物科学股份 有限公司	SEL B US	纳斯达克 证 券 交 易 所	美国	2,011	16,274.81	0.02
24 4	Atara Biotherapeutics Inc	Atara 生物 医药股份有 限公司	ATR A US	纳斯达克 证 券 交 易 所	美国	1,284	14,937.46	0.01
24 5	Cara Therapeutics Inc	Cara Therapeuti cs 公司	CAR A US	纳斯达克 证 券 交 易 所	美国	708	14,477.90	0.01



				交易所				
24 6	Poseida Therapeutics Inc	-	PST X US	纳斯达克 证券交易 所	美国	1,137	14,459.69	0.01
24 7	Graphite Bio Inc	-	GRP H US	纳斯达克 证券交易 所	美国	761	14,296.97	0.01
24 8	BioAtla Inc	-	BCA B US	纳斯达克 证券交易 所	美国	625	13,548.38	0.01
24 9	Kinnate Biopharma Inc	-	KNT E US	纳斯达克 证券交易 所	美国	611	13,377.34	0.01
25 0	Absci Corp	-	ABS I US	纳斯达克 证	美国	1,212	13,311.66	0.01

				券交易所				
25 1	Optinose Inc	-	OPT N US	纳斯达克证 券交易所	美国	1,468	13,047.19	0.01
25 2	Adaptimmune Therapeutics Plc	Adaptimmun e 治疗公共 有限公司	ADA P US	纳斯达克证 券交易所	美国	1,918	12,819.65	0.01
25 3	C4 Therapeutics Inc	-	CCC C US	纳斯达克证 券交易所	美国	643	12,777.02	0.01
25 4	Esperion Therapeutics Inc	Esperion Therapeuti cs 公司	ESP R US	纳斯达克证 券交易所	美国	1,241	12,464.43	0.01
25 5	G1 Therapeutics Inc	-	GTH X US	纳斯达克	美国	677	12,180.75	0.01

				证 券 交 易 所				
25 6	Alaunos Therapeutics Inc	Alaunos Therapeuti cs 股份有限 公司	TCR T US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	3,154	11,622.99	0.01
25 7	Inovio Pharmaceuticals Inc	Inovio 制药 股份有限公 司	INO US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	3,444	11,111.47	0.01
25 8	Invivyd Inc	-	IVV D US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	1,435	10,887.47	0.01
25 9	Gossamer Bio Inc	-	GOS S US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	1,251	10,847.37	0.01
26 0	Nektar Therapeutics	内克塔治疗 公司	NKT R US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	2,481	10,311.72	0.01

				克 证 券 交 易 所				
26 1	Nkarta Inc	-	NKT X US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	641	10,143.51	0.01
26 2	Adicet Bio Inc	-	ACE T US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	563	9,885.54	0.01
26 3	Affimed NV	Affimed 公 司	AFM D US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	1,957	8,459.10	0.01
26 4	Instil Bio Inc	-	TIL US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	1,705	6,788.35	0.01
26 5	Cue Health Inc	-	HLT H	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	1,987	5,297.96	0.01

			US	达 克 证 券 交 易 所				
26 6	GreenLight Biosciences Holdings PBC	-	GRN A US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	1,988	4,282.15	0.00
26 7	Eiger BioPharmaceutica ls Inc	Eiger 生物 制药有限公司	EIG R US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	580	2,950.44	0.00
26 8	Evelo Biosciences Inc	-	EVL O US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	72	1,690.84	0.00

7.4.2 积极投资期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资  
明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	公司名称（中文）	证券代码	所在证券	所属国家（地区）	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
----	----------	----------	------	------	----------	-------	------	--------------

				市场				
1	BELLUS Health Inc	BELLUS 健康股份有限公司	BLU US	纳斯达克证券交易所	美国	1,634	174,034.55	0.17

## 7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

### 7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	Amgen Inc	AMGN US	6,966,394.73	9.25
2	Gilead Sciences Inc	GILD US	6,355,971.79	8.44
3	Regeneron Pharmaceuticals Inc	REGN US	5,949,229.48	7.90
4	Vertex Pharmaceuticals Inc	VRTX US	5,790,389.48	7.69
5	Moderna Inc	MRNA US	3,818,505.48	5.07
6	AstraZeneca PLC	AZN US	2,886,318.07	3.83
7	Biogen Inc	BIIB US	2,765,262.79	3.67
8	Seagen Inc	SGEN US	2,423,845.81	3.22
9	Illumina Inc	ILMN US	2,214,203.09	2.94
10	Alnylam Pharmaceuticals Inc	ALNY US	1,747,715.79	2.32
11	Horizon Therapeutics Plc	HZNP US	1,649,868.15	2.19
12	BioMarin Pharmaceutical Inc	BMRN US	1,225,315.04	1.63
13	Incyte Corp	INCY US	1,088,619.38	1.44
14	Royalty Pharma PLC	RPRX US	1,053,703.20	1.40
15	Sanofi	SNY US	1,039,202.36	1.38
16	Sarepta Therapeutics Inc	SRPT US	844,124.99	1.12
17	Viatis Inc	VTRS US	840,192.71	1.12
18	Argenx SE	ARGX US	800,761.12	1.06

19	United Therapeutics Corp	UTHR US	790,693.17	1.05
20	BioNTech SE	BNTX US	787,661.26	1.05

注：本项“买入金额”按买入成交金额填列，不考虑相关交易费用。

### 7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	Vertex Pharmaceuticals Inc	VRTX US	4,209,291.66	5.59
2	Regeneron Pharmaceuticals Inc	REGN US	4,157,102.09	5.52
3	Gilead Sciences Inc	GILD US	3,893,923.44	5.17
4	Amgen Inc	AMGN US	3,754,448.38	4.98
5	Moderna Inc	MRNA US	2,657,094.09	3.53
6	AstraZeneca PLC	AZN US	2,221,696.54	2.95
7	Biogen Inc	BIIB US	1,978,768.37	2.63
8	Seagen Inc	SGEN US	1,693,460.96	2.25
9	Illumina Inc	ILMN US	1,525,147.29	2.02
10	Anylam Pharmaceuticals Inc	ALNY US	1,249,680.14	1.66
11	Prometheus Biosciences Inc	RXDX US	1,209,231.72	1.61
12	Horizon Therapeutics Plc	HZNP US	1,158,554.87	1.54
13	BioMarin Pharmaceutical Inc	BMRN US	841,429.95	1.12
14	Incyte Corp	INCY US	775,739.76	1.03
15	Royalty Pharma PLC	RPRX US	720,168.30	0.96
16	Sanofi	SNY US	717,860.71	0.95
17	Argenx SE	ARGX US	611,293.57	0.81
18	BeiGene Ltd	BGNE US	602,209.62	0.80
19	Viartis Inc	VTRS US	586,105.74	0.78
20	Sarepta Therapeutics Inc	SRPT US	576,296.23	0.76

注：本项“卖出金额”按卖出成交金额填列，不考虑相关交易费用。

### 7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	77,846,079.94
卖出收入（成交）总额	53,915,358.33

注：“买入成本”、“卖出收入”均按买入或卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

## 7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

## 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

## 7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

注：本基金本报告期末未持有金融衍生品。

## 7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

注：本基金本报告期末未持有基金投资。

## 7.11 投资组合报告附注

### 7.11.1

报告期内本基金投资前十名证券的发行主体没有被中国人民银行及其派出机构、国家金融监督管理总局（前身为中国银保监会）及其派出机构、中国证监会及其派出机构、国家市场监督管理总局及机关单位、交易所立案调查，或在报告编制日前一年内收到公开谴责、处罚的情况。

### 7.11.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

### 7.11.3 期末其他各项资产构成

注：本基金本报告期末无其他资产。

### 7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明



注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构					
		机构投资者		个人投资者		中国银行股份有限公司-汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(QDII)	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
1,588	58,609.65	52,034,132.00	55.91	41,037,988.00	44.09	33,706,800.00	36.22

注：机构投资者“持有份额”和“占总份额比例”数据中包含“汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(QDII)”的“持有份额”和“占总份额比例”数据。

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例(%)
1	海南否证私募基金管理合伙企业(有限合伙)-升科否证私募证券投资基金	8,887,900.00	9.55
2	MORGAN STANLEY & CO. INTERNATIONAL PLC.	2,119,000.00	2.28
3	广发证券股份有限公司	1,851,797.00	1.99
4	陈永红	1,373,200.00	1.48
5	于和智	1,235,200.00	1.33
6	中信建投证券股份有限公司	1,091,600.00	1.17
7	林洁丽	1,029,900.00	1.11
8	陈宜明	940,000.00	1.01

9	孙建平	892,100.00	0.96
10	曹斌	850,000.00	0.91
11	中国银行股份有限公司- 汇添富纳斯达克生物科技 交易型开放式指数证券投资 基金发起式联接基金 (QDII)	33,706,800.00	36.22

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：期末基金管理人的从业人员未持有本基金。

### 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2022年08月15日）基金份额总额	282,072,120.00
本报告期期初基金份额总额	70,072,120.00
本报告期基金总申购份额	76,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	53,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	93,072,120.00

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产的重大诉讼事项。

本报告期内，无涉及本基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，为本基金进行审计的机构未发生变化，为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内未发生基金管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情形。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
Jefferies International	-	84,253,595.99	64.43	18,147.75	34.46	
Sanford C. Bernstein	-	46,511,807.70	35.57	34,513.17	65.54	
长江证券	1	-	-	-	-	

东方证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中信建投证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-

注:此处的佣金指通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该券商的佣金合计,不单指股票交易佣金。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期基金成交总额的比例 (%)
Jefferies International	-	-	-	-	-	-	-	-
Sanford C. Bernstein	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-

注:1、专用交易单元的选择标准和程序:

- (1) 基金交易单元选择和成交量的分配工作由投资研究部统一负责组织、协调和监督。
- (2) 交易单元分配的目标是按照证监会的有关规定和对券商服务的评价控制交易单元的分配比例。
- (3) 投资研究部根据评分的结果决定本月的交易单元分配比例。其标准是按照上个月券商评分决定本月的交易单元拟分配比例,并在综合考察年度券商的综合排名及累计的交易分配量的基础上进行调整,使得总的交易量的分配符合综合排名,同时每个交易单元的分配量不

超过总成交量的 30%。

(4) 每半年综合考虑近半年及最新的评分情况，作为增加或更换券商交易单元的依据。

(5) 调整租用交易单元的选择及决定交易单元成交量的分布情况由投资研究部决定，投资总监审批。

(6) 成交量分布的决定应于每月第一个工作日完成；更换券商交易单元的决定于合同到期前一个月完成。

(7) 调整和更换交易单元所涉及到的交易单元运行费及其他相关费用，基金会计应负责协助及时催缴。

(8) 按照《关于基金管理公司向会员租用交易单元有关事项的通知》规定，同一基金管理公司托管在同一托管银行的基金可以共用同一交易单元进行交易。

## 2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

本基金本报告期内新增 2 家证券公司的 3 个交易单元：民生证券（深交所单元，上交所单元）、长江证券（深交所单元）。

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）因境外主要市场节假日暂停申购、赎回业务的公告	中证报, 上交所, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 01 月 12 日
2	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2022 年第四季度报告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 01 月 20 日
3	关于汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）因境外主要市场节假日暂停申购、赎回业务的公告	中证报, 上交所, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 02 月 16 日
4	汇添富基金管理股份有限公司旗下部分基金更新招募说明书及基金产品资料概要	上交所, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 02 月 22 日
5	关于防范不法分子冒用汇添富基金名义进行非法活动的重要提示	公司网站	2023 年 03 月 13 日
6	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2022 年年度报告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 03 月 31 日

7	关于汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）因境外主要市场节假日暂停申购、赎回业务的公告	中证报, 上交所, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 04 月 04 日
8	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金变更扩位证券简称和场内简称的公告	上交所, 上证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 04 月 13 日
9	汇添富基金管理股份有限公司旗下部分基金更新产品资料概要	上交所, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 04 月 18 日
10	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2023 年第一季度报告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 04 月 21 日
11	关于汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）因境外主要市场节假日暂停申购、赎回业务的公告	中证报, 上交所, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 05 月 25 日
12	关于汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）因境外主要市场节假日暂停申购、赎回业务的公告	中证报, 上交所, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 06 月 15 日
13	关于汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）因境外主要市场节假日暂停申购、赎回业务的公告	中证报, 上交所, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 06 月 30 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
中国银行	1	2023 年 4 月	-	33,706,800.00	-	33,706,800.00	36.22

股份有限公司—汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金		28 日至 2023 年 6 月 30 日									
产品特有风险											
<p>1、持有人大会投票权集中的风险                      当基金份额集中度较高时，少数基金份额持有人所持有的基金份额占比较高，其在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。</p> <p>2、基金规模较小导致的风险                      持有基金份额比例较高的投资者集中赎回后，可能导致基金规模较小，基金持续稳定运作可能面临一定困难。本基金管理人将继续勤勉尽责，执行相关投资策略，力争实现投资目标。</p> <p>3、提前终止基金合同的风险                      持有基金份额比例较高的投资者集中赎回后，可能导致在其赎回后本基金资产规模长期低于 5000 万元，进而可能导致本基金终止、转换运作方式或与其他基金合并。</p>											

## 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）募集的文件；
- 2、《汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金合同》；

- 3、《汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、报告期内汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）在规定的报刊上披露的各项公告；
- 6、中国证监会要求的其他文件。

## 12.2 存放地点

上海市黄浦区外马路 728 号 汇添富基金管理股份有限公司

## 12.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅，或登录基金管理人网站 [www.99fund.com](http://www.99fund.com) 查阅，还可拨打基金管理人客户服务中心电话：400-888-9918 查询相关信息。

汇添富基金管理股份有限公司

2023 年 08 月 31 日